

华鑫证券有限责任公司

【华鑫证券鑫享添利 2 号】
集合资产管理计划资产管理合同

合同编号：【HXZQ-XXTL-202209-2】

管理人：华鑫证券有限责任公司

托管人：上海银行股份有限公司

目录

第一部分 前言	4
第二部分 释义	5
第三部分 承诺与声明	8
第四部分 当事人及权利义务	9
第五部分 本计划的基本情况	15
第六部分 本计划的募集	17
第七部分 本计划的成立与备案	21
第八部分 本计划的参与、退出与转让	22
第九部分 份额持有人大会及日常机构	31
第十部分 计划份额的登记	31
第十一部分 资产管理计划的投资	32
第十二部分 投资顾问	39
第十三部分 分级安排	39
第十四部分 利益冲突及关联交易	39
第十五部分 投资经理的指定与变更	40
第十六部分 资产管理计划的财产	41
第十七部分 投资指令的发送、确认和执行	42
第十八部分 越权交易的界定	46
第十九部分 资产管理计划财产的估值和会计核算	49
第二十部分 资产管理计划的费用与税收	56
第二十一部分 资产管理计划的收益分配	60
第二十二部分 信息披露与报告	61
第二十三部分 风险揭示	64
第二十四部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算	79
第二十五部分 违约责任	84
第二十六部分 争议的处理	86
第二十七部分 资产管理合同的效力	86
第二十八部分 其他事项	87
附件一：专用清算账户及资金划拨专用账户	89
附件二：管理人关联方名单	90
附件三：托管人关联方名单	91
附件四：预留印鉴授权书	92
附件五：资产管理人指定发送邮箱	93
附件六：华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书	94

重要提示

特别约定：《华鑫证券鑫享添利 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以纸质或中登电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（华鑫证券鑫享添利 2 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以纸质或中登电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。

投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者通过销售机构认可的有效身份验证措施登录相关网络系统后，以中登电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。

本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。在集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。

第一部分 前言

一、订立本资产管理合同的依据、目的和原则

(一) 订立本资产管理合同(以下简称“本合同”)的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发[2018]106号,以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令[第151号],以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(证监会公告[2018]31号,以下简称《运作管理规定》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》(证监会公告[2016]13号,以下简称《暂行规定》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引(试行)》及其他有关法律法规的规定。

若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突,应当以届时有效的法律法规的规定为准,各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

(二) 订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下,保护本合同各当事人合法权益,明确本合同各当事人之间权利和义务,保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。

(三) 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平,充分保护本合同各当事人的合法权益。

二、投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间,投资者自全部退出资产管理计划之日起,该投资者不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

三、管理人应当对本集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会(以下简称“协会”)进行备案。

四、证券投资基金业协会接受本计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表协会对本计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

五、投资者承诺以真实身份参与集合计划,并符合《管理办法》、《运作管理

规定》、《指导意见》及本合同中关于“合格投资者”的要求，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知本合同和《说明书》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。投资者承诺投资者为合格投资者，并配合提供相关证明材料。

投资者承诺已经履行反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，不得将自有资金和募集资金混同操作。并在签订本合同前，已经签署了风险揭示书及客户风险承受能力调查表，投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，并根据自身能力审慎决策参与本计划，对投资行为承担完全后果，独立承担投资风险。

六、管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

七、托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，保护委托资产的安全，但不保证委托资产本金不受损失或取得最低收益。

八、本集合计划为【固收类】资产管理计划，本集合计划在投资过程中可能面临多种风险，包括但不限于市场风险、政策法律风险、金融监管风险、信用风险、管理风险、流动性风险等；此外，本集合计划可能面临提前终止的风险。

投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的资产管理合同与风险揭示书，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

九、管理人与销售机构（如有）为不同法律实体，管理人已提示销售机构履行销售适当性管理义务，并已提示投资者审慎规避违规、不当销售行为，如销售机构仍然违规或不当实施销售行为，则由销售机构对投资者承担责任。

十、本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。

第二部分 释义

在本合同中，除非上下文另有规定外，下列词语或简称具有如下含义：

1、资产管理计划、集合计划、计划、本计划：指华鑫证券鑫享添利2号集合资

产管理计划。

2、资产管理合同、本合同：指投资者、管理人及托管人三方签署的《华鑫证券鑫享添利2号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更及补充。

3、计划说明书：指《华鑫证券鑫享添利2号集合资产管理计划说明书》及其附件，以及对该计划说明书及附件做出的任何有效变更及补充。

4、法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件、监管政策、自律规则以及对该等法律法规不时的修订和补充。

5、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》。

6、《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于2018年4月27日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号）。

7、《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第151号〕）。

8、《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31号）。

9、中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会。

10、证券投资基金业协会、基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

11、投资者：指签订本合同且根据本合同及相关文件合法取得本计划份额的、符合《指导意见》和《运作规定》规定条件的合格投资者。

12、资产管理人、管理人：指华鑫证券有限责任公司。

13、资产托管人、托管人：指上海银行股份有限公司。

14、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为华鑫证券有限责任公司。

15、销售机构：指管理人及其指定的销售机构，本计划销售机构为华鑫证券有限责任公司。（管理人有权以管理人网站公告方式增加其他销售机构）

16、初始募集期：指自本计划发售之日起不超过60日的期间，具体初始募集期以本计划销售公告或说明书为准。

17、封闭期：本计划的首个封闭期为自本合同生效日起至第一个开放日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放日之间的期间（不含开放日）。

18、存续期：指本合同生效至终止之间的期限。

19、开放期：指在非计划初始募集期，管理人办理本计划参与、退出等业务的期间。

20、本合同生效日、资产管理计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。

21、工作日：指管理人和托管人均办理相关业务的营业日。

22、认购：指在本计划初始募集期内，投资者按照本合同的参与本计划的行为。

23、参与、申购(本计划)：指在本计划开放期内，投资者按照本合同及指定销售机构规定的手续，参与本计划的行为。

24、退出(本计划)：指在本计划开放期内，投资者按照本合同及指定销售机构规定的手续，申请部分或全部退出本计划的行为。

25、元：指人民币元。

26、资产管理计划财产、资产管理计划资产、计划财产、计划资产：指投资者拥有合法处分权、由管理人管理并由托管人托管的作为本合同标的的财产。

27、计划资产总值、资产总值：指管理人和托管人根据本合同约定的估值方法对本合同项下各种形式资产管理计划财产计算的价值总和，具体指本计划财产拥有的各类有价证券、银行存款本息、证券投资基金份额及其他资产的价值总和。

28、计划资产净值：指计划资产总值减去计划负债后的价值。

29、计划财产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定计划资产净值和计划份额净值的过程。

30、计划份额净值、份额净值、单位净值：指计算日计划资产净值除以当日资产管理计划份额余额总数后得出的资产管理计划每份额资产净值。

31、计划份额累计净值：指计划份额净值与资产管理计划历来份额收益分配金额之和。

32、流动性受限资产：是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受

限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产

33、7个工作日可变现资产：包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

34、每年：指会计年度。

35、不可抗力：指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、法律法规、监管政策调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件。

36、信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规、监管规定和合同约定，尽职履行托管人职责。

37、投资指令：指划款指令。

38、天：指自然日。

39、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所等相关交易场所的正常交易日。

40、交易时间：指上海证券交易所、深圳证券交易所等相关交易场所的正常交易时间。

第三部分 承诺与声明

一、管理人承诺在签订本合同前已充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，充分揭示了相关风险，并已了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。管理人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

二、托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。托管人具备为本集合计划提供托管服务的资质和内部授权。托管人承诺根据法律法规、中国证监会及协会的

规定和本合同约定，对管理人的投资或清算指令进行监督。在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及本合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）。托管人承诺根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份和交易资料留存、大额交易和可疑交易报告，并为资产管理人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

三、投资者保证为符合《运作规定》合格投资者的要求，以真实身份参与集合计划，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。投资者承诺投资者投资于资产管理计划的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对本计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。投资者保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人对该资产管理计划财产行使投资管理权；保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行资产管理计划财产的投资管理和托管业务，而且该等委托不会为任何其他第三方所质疑。

第四部分 当事人及权利义务

一、合同当事人

（一）投资者

姓名/名称：

住所：

联系人：

通讯地址：

联系电话：

(二) 管理人

姓名/名称：华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

法定代表人：俞洋

联系人：刘帆

通讯地址：上海市徐汇区肇嘉浜路 750 号华鑫证券

联系电话：021-54967795

(三) 托管人

名称：上海银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

邮编：200120

联系人：施晨杰

联系电话：021-68475888

二、本计划设定为均等份额，除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

三、本计划投资者的权利包括但不限于：

(一) 分享本计划财产收益；

(二) 取得分配清算后的剩余计划财产；

(三) 按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；

(四) 根据本合同的规定，参加或申请召集本计划份额持有人大会（如有），行使相关职权；

(五) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；

(六) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；

(七) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

四、本计划投资者的义务包括但不限于：

(一) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；

(二) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；

(三) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(四) 认真阅读并签署风险揭示书；

(五) 按照本合同约定支付本计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(六) 在持有的本计划份额范围内，承担本计划亏损或者终止的有限责任；

(七) 向管理人或本计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(八) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

(九) 不得从事任何有损本计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(十) 保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(十一) 如投资者资金来源为募集资金，投资者保证委托资产的来源及用途合法，承诺已经在募集资金环节履行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，管理人无需对投资者募集资金客户履行反洗钱职责。投资者不得将自有资金和募集资金混同操作；投资者在初始和持续募集资金过程中不得接受资管产品作为募集资金来源；如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透后的投资者信息资料表的，投资者应配合提供；投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为；

(十二) 投资者应当听取管理人或销售机构的适当性匹配意见并进行自主决策，在购买本产品或接受相应服务时，应当按照管理人和销售机构明示的要求提供管理人和销售机构履行适当性管理和开展反洗钱工作所需的真实信息。如投资者向管理人或销售机构提供虚假信息或证明材料，管理人、销售机构据此作出销售产品或提

供金融服务行为的，由投资者自行承担不利后果及责任。

（十三）在本计划存续期间及时关注管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告；

（十四）理解并同意承担资产管理计划财产的投资、运作、托管面临包括但不限于本合同“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险；

（十五）法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

五、管理人的权利包括但不限于：

（一）按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

（二）按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

（三）按照有关规定和本合同约定行使因本计划财产投资所产生的权利；

（四）根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告证监会相关派出机构；

（五）自行提供或者委托经中国证监会、协会认定的服务机构为本计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

（六）以管理人的名义，代表本计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

（七）管理人或销售机构已按规定向投资者进行揭示（含不时发布的公告和沟通函件）或提出建议而投资者拒绝听取的，管理人、销售机构不承担投资者自主决定认购、持有、赎回等所产生的责任。

（八）管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个投资者首次参与金额、追加参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整，但应符合法律法规的规定；

（九）有权对投资者进行尽职调查，要求投资者提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

（十）法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

六、管理人的义务包括但不限于：

（一）依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；

（二）按照协会要求报送本计划运行信息；

(三) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本计划财产；

(四) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(五) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(六) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本计划财产；

(七) 建立健全的内部管理制度，保证本计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

(八) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本计划财产；

(九) 保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；

(十) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动；

(十一) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(十二) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；

(十三) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(十四) 召集本计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）；

(十五) 按照本合同约定计算并向投资者报告本计划份额净值；

(十六) 确定本计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(十七) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(十八) 按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；

(十九) 聘请符合《证券法》相关规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(二十) 按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(二十一) 根据法律法规与本合同约定，编制向投资者披露的本计划季度、年度等定期报告；

(二十二) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(二十三) 建立并保存投资者名单；

(二十四) 组织并参加本计划财产清算小组，参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(二十五) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存本计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年；

(二十六) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、协会并通知托管人和投资者；

(二十七) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

七、托管人的权利包括但不限于：

(一) 按照本合同约定，依法保管本计划财产；

(二) 按照本合同约定，及时、足额获得本计划托管费用；

(三) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

八、托管人的义务包括但不限于：

(一) 安全保管本计划财产；

(二) 除依据法律法规规定和本合同约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管本计划财产；

(三) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保本计划财产的完整与独立；

(四) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动；

(五) 按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户；

(六) 复核本计划资产净值和份额净值；

(七) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项；

(八) 根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的本计划财产的定期报告，并出具书面意见；

(九) 编制托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构；

(十) 按照法律法规要求和本合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(十一) 在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照本合同约定召集份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）。

(十二) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(十三) 根据法律法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不得少于20年；

(十四) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；

(十五) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

(十六) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

第五部分 本计划的基本情况

一、本计划的基本情况：

(一) 本计划的名称

华鑫证券鑫享添利2号集合资产管理计划

(二) 本计划的类别【开放式固定收益类】集合资产管理计划

(三) 是否为基金中基金资产管理计划（FOF）或管理人中管理人资产管理计划（MOM）：【否】

(四) 本计划的运作方式【开放式】

（五）本计划的投资目标

管理人将在本合同约定的投资范围内，力争为计划资产获取稳健回报。

（六）本计划的投资范围

固定收益类及现金管理类资产：国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包含二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、永续债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、项目收益债、金融机构次级债、可转换债券、可交换债券（含非公开发行的可交换债券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、在交易所及银行间市场挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、债券型基金、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款），以及银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司等发行的固定收益类资产管理产品。

本计划投资于其他资产管理产品的，所投资资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

本集合计划不投资于本管理人所设立的资产管理产品。

本集合计划可以依法参与债券回购业务，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。

（七）本计划的投资比例

1、投资于固定收益类及现金管理类资产的比例不得低于资产管理计划总资产的80%；

2、债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的0-100%。

（八）本计划的产品风险等级

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为R2，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C2-C5】的普通投资者】，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单

一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历或投资经验等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。

（九）本计划的存续期限

本计划存续期限为自成立之日起【十】年。

（十）本计划份额的初始募集面值为1元。

（十一）本集合计划在销售期的募集资金（不含销售期利息）不低于1,000万元（含本数），募集规模及存续期规模上限以管理人公告为准；本集合计划投资者合计数为2人（含）以上200人（含）以下。

（十二）本计划的分级安排

本计划不设置份额分级。

（十三）服务机构信息

本计划的份额登记机构、估值与核算、信息技术服务机构为华鑫证券有限责任公司。管理人未委托其他服务机构代为办理本计划的估值与核算、信息技术服务。

第六部分 本计划的募集

一、本计划的募集对象

本计划向合格投资者非公开募集，合格投资者不少于2人，且累计不得超过200人。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于【30】万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（一）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元。

（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；

（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(五) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R2，仅适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C2-C5】的普通投资者】，具体以销售机构确认的风险等级为准。

二、本计划的募集方式

本计划将通过管理人的直销渠道/销售机构向特定客户进行销售，本计划销售机构为【华鑫证券有限责任公司直销渠道、华鑫证券有限责任公司以及管理人认可并与其签署相关协议的其他销售机构】。管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告，管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者意见或与投资者另行签订协议。

投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。

销售机构应将本计划资产管理合同、计划说明书等正式推广文件，以纸质或电子方式置备于销售机构。本计划应当面向合格投资者推广，客户风险承受能力应与本计划相匹配，销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广本计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，通过管理人、中国基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露本计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使投资者详尽了解本计划的特性、风险等情况及投资者的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得公开或变相公开募集资产管理计划，不得通过报刊、电台、电视、

互联网等传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体等方式向不特定对象推广本计划。

三、本计划的募集期限

本计划初始募集期自计划份额发售之日起不超过 60 天，具体时间由管理人根据相关法律法规以及本合同确定，并在管理人公告中披露。

四、本计划认购费用

本计划的认购费率为【0】%。

认购费用的计算方式：认购费用=认购金额*认购费率

五、本计划认购申请的确认

（一）认购程序。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

（二）认购申请的确认。投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内认购资金不足，销售机构不受理该笔认购申请。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请，申请是否有效应以注册登记机构的确认并且本合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。投资者承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤销指定账户，并妥善保管账户资料，由于投资者原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失，由投资者承担，管理人和托管人不承担责任。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准；

（三）投资者签署本合同后，方可申请认购集合计划；投资者的认购申请经注册登记机构确认有效后，构成本合同的有效组成部分；投资者认购申请确认后，其认购申请和认购资金不得撤销。

（四）注册登记机构可按照“时间优先，金额优先”的原则在初始募集期届满后对认购金额申请予以确认。在采用本原则进行确认时，认购时间在前者被优先确认，认购时间相同时认购金额高的投资者优先被确认。

对未被确认的投资人，管理人应在初始募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额，并加计银行同期活期存款利息。

(五) 本集合计划采用电子签名合同的方式签署的, 投资者应当根据销售机构的要求签署纸质的电子签名约定书或如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料, 销售机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整, 否则应当承担由此造成的一切后果。投资者根据销售机构的程序, 到销售机构指定网点或管理人直销柜台申请参与集合计划, 或登录销售机构指定网络系统以自主下单方式申请参与集合计划。

六、认购份额的计算方式

认购份额的计算方法如下:

认购份数 = (认购金额 + 认购期间的利息) / 资产管理计划份额初始销售面值

认购份额的计算保留到小数点后 2 位, 小数点后 2 位以后的部分舍去, 舍去部分归入资产管理计划资产。

七、初始认购资金的管理及利息处理方式

管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于下列计划募集结算专用账户, 在本计划初始募集行为结束前, 任何个人和机构不得动用。

户名: 华鑫证券有限责任公司

账号: 98300153400000075

开户行: 上海浦发银行徐汇支行

八、本计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。投资者初始单笔认购金额不低于【30】万元人民币(不含认购费用)并可追加认购, 追加认购金额需为 1 万元人民币的整数倍, 首次参与超过最低认购金额的部分及追加参与不设金额级差。首次参与指提出参与本集合计划申请的投资者在参与之前未持有本集合计划份额的情形。管理人可公告调整本集合计划首次参与和追加参与时的最低参与金额。

九、募集账户

本集合计划管理人募集结算专用账户信息见上述第七条“初始认购资金的管理及利息处理方式”。直销柜台募集结算账户将以管理人官网披露的方式向投资者进行披露, 投资者可在管理人处查询。其他销售机构委托募集账户信息(如有)由销售机构向投资者进行披露, 投资者可在销售机构处查询。

华鑫证券有限责任公司作为运营服务机构, 为【管理人直销渠道】募集结算资

金归集专用账户提供管理服务，对【管理人直销渠道】募集结算资金实施监督。各方确认：管理人委托的运营服务机构（华鑫证券有限责任公司）不对其直销渠道以外的募集账户承担监管义务。

第七部分 本计划的成立与备案

一、本计划成立的条件

- （一）本计划初始募集规模不低于 1000 万元；
- （二）投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- （三）募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。
- （四）符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

二、本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托符合《证券法》相关规定的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。管理人应在本计划成立起 5 个工作日内报协会备案。本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

三、本计划募集失败的处理方式

募集期届满，本计划未达到本合同约定的成立条件的，本计划募集失败，则管理人应当承担下列责任：

- （一）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- （二）在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。返还完毕各方互不承担任何其他责任。

由于监管政策及指导意见的不时更新与变动，本计划可能存在无法成立或无法进行备案的风险，全体投资者确认，管理人及托管人对此不承担任何责任。

四、本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，管理人开展投资活动前，应及时向托管人发送成立通知及计划已通过协会备案的材料。符合本合同约定，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

第八部分 本计划的参与、退出与转让

一、本计划运作期间的开放期内，投资者可办理参与和退出业务。

二、参与和退出场所

本计划参与和退出场所为管理人、管理人直销渠道及管理人委托的各销售机构的营业网点，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。管理人可根据情况新增或变更本集合计划的销售机构，将提前在管理人指定网站上公告，管理人网站公告后即生效。具体销售机构名单、联系方式以管理人网站的公示为准。

三、参与和退出的开放日和开放时间

本集合计划原则上定期开放，开放期为产品自首次封闭期结束后每周的周二、周三、周四（若开放期遇法定节假日、非工作日，则当日不开放，且开放期不顺延），首次封闭期为自成立之日起至满1个月之日，管理人有权以公告方式提前结束封闭期。投资者可以在开放期办理参与、退出业务（管理人公告暂停参与、退出时除外）。

管理人有权根据实际情况调整开放期，但管理人应提前1个工作日告知投资者和托管人具体的开放时间。

业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常工作日的交易时间。管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中7个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的10%，按规定限制或暂停退出的情况除外。管理人主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合资产管理计划资产净值的20%。

四、管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放日。管理人应提前至少1个工作日在管理人网站公告具体安排。

1、临时开放日适用于：

（1）因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与集合计划被动超限的，管理人通过设置临时开放期办理超出份额的退出手续；

（2）在合同变更或展期时，管理人通过设置临时开放日的方式，合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利（但不得参与本集合计划）；

（3）因无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障、金融市场危机、行业竞争、代销机构违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险或不可抗力因素的出现，导致集合计划资产无法正常运作或出现损失或投资

者利益受损的情况，为合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，可设置临时开放日（但不得参与本集合计划）。

管理人不得利用临时开放期变更开放募集，从而突破《运作规定》对于开放次数的限制。

2、封闭期

本集合计划封闭期为自成立之日起至满1个月之日，管理人有权以公告方式提前结束封闭期。此外，非开放期均为封闭期，该期间内不办理参与和退出业务。

3、若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

五、参与和退出的方式、价格、程序及确认

（一）“未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以参与和退出申请提交日所在交易日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

（二）本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

（三）投资者办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

（四）当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

（五）参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。当日（T日）在交易时间内提交的参与/退出申请，管理人及注册登记机构在收到投资者退出/参与申请的T+1日内对该交易的有效性进行确认，投资者原则上可在T+2日后到销售网点查询退出/参与的确切情况。巨额退出的情形按本部分第十条巨额退出及连续巨额退出的认定及办理方式办理。

（六）参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。在提交退出申请时须持有足够的资产管理计划份额余额，否则为无效申

请。投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出投资者的指定资金账户，退出款项将在 T+【2】日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理合同》所述暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

（七）管理人在不损害投资者权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知投资者。管理人提前 3 个工作日在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。同时，管理人应提前书面告知销售机构。

六、参与和退出的金额限制

投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应不低于【30】万元人民币（不含参与费用），已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。现有投资者在本计划存续期开放期追加本计划份额的，单笔追加金额应不低于 1 万元人民币（不含参与费用）。

当投资者持有的计划份额所对应的资产净值高于【30】万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出本计划份额；选择部分退出本计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额所对应的资产净值不得低于【30】万元。当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币的，管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划份额所对应的资产净值不低于【30】万元。当投资者持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币（含【30】万元人民币）时，需要退出本计划的，投资者必须选择一次性全部退出本计划。

如出现临时开放的情况，退出原则如下：

1、投资者退出时只能一次性退出其持有的全部集合计划份额，如其该笔退出申请并非持有的集合计划全部份额时，则视为投资者同意管理人作出相应合同变更、展期等安排。

2、本集合计划采用份额退出的方式，即退出以份额申请。

3、本集合计划采用“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出日（T 日）

集合计划份额单位净值为基准进行计算。

4、当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销。

在符合上述规定的前提下，管理人可根据市场情况，在不违反证监会及基金业协会等规定且不损害投资者权益的前提下合理调整对参与金额和退出份额的数量限制并告知投资者。管理人和销售机构在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

七、参与和退出的费用

本计划参与费率为【0】%，退出费率为【0】%。

参与费用=参与金额*费率

退出费用=退出份额*份额净值*费率

八、参与份额和退出金额的计算方式

（一）本计划参与份额的计算方式

本计划参与份额的计算方式如下：

参与份额=（参与总金额-参与费用）/参与申请所在交易日的资产管理计划份额净值

其中，参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

（二）本计划退出金额的计算方式

本计划退出金额的计算方式如下：

退出总额=退出份额×退出申请所在交易日的资产管理计划份额净值

退出金额=退出总额-退出费用/业绩报酬（若有）

其中，退出总额和退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

管理人可以在法律法规和本合同规定范围内调低参与费率、调低退出费率。如有调整，管理人应在调整实施前3个工作日告知投资者。管理人和销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

九、参与资金的利息处理方式（如有）

投资者在初始销售期内的参与资金产生的利息将折算为计划份额归投资者所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。存续期参与资金无相关利息，不进行利息转

份额的处理。

十、巨额退出和连续巨额退出

（一）认定标准

若本计划于某个开放期内的计划份额净退出申请超过前一交易日的计划总份额的【10%】，即认定为计划发生了巨额退出。

同一开放期内连续2个开放日以上（含2个交易日）发生巨额退出，即认定为计划发生了连续巨额退出。

（二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

当出现连续巨额退出时，如果集合计划管理人根据本集合计划当时的资产组合状况按照上述巨额退出的处理方式对投资者的退出申请，采取全额退出或部分顺延退出的方式逐日能够满足投资者的退出要求时，按巨额退出的处理方式办理。

当集合计划管理人认为连续支付投资者的退出申请确有困难或认为连续支付投资者的退出申请对集合计划的资产净值造成很大波动时，管理人可以暂停接受退出申请。但暂停期限不得超过20个工作日。已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

1. 全额退出：当管理人认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。

2. 部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出的总份额不低于当日集合计划上一日总份额10%的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。巨额退出仍遵循“先进先出”原则。退出金额以后续开放日的集合资产管理计划份额净值为依据计算，并通过管理人网站向投资者公告。

（三）告知客户方式

当发生巨额退出并延期支付时，管理人应当在3个工作日内在其网站上发布公告。管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了向投资者告知的义务。

（四）单个投资者大额退出的预约申请

单个投资者单日退出份额超过集合计划总份额【5%】，即视为单个投资者大额退出。单个投资者的单笔退出为巨额退出的情况下，该投资者必须在开放期之前至少提前3个交易日向管理人提交预约退出申请。

十一、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

（一）因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

（二）发生本合同规定的暂停基金资产估值情况。

（三）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。

（四）发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。

（五）发生巨额退出、连续巨额退出的情形。

（六）当前一估值日计划资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延期支付退出款项或延期办理退出申请。

（七）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定延期支付或延期支付时，已确认的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。在延期退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

十二、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式；

（一）在如下情况下，管理人可以拒绝或暂停接受投资者的参与申请：

1. 初始募集期和存续期内，本集合计划投资者人数或规模接近或达到合同约定的最高规模上限（如有）；

2. 集合计划资产规模过大，根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者的利益的情形；

3. 因本计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有投资者利益的；。

4. 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他投资者利益的；

5. 证券、期货交易所在交易时间非正常停市；

6. 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

7. 投资者经过管理人和销售机构认可后方可参与本集合计划。管理人和销售机构有权拒绝未经认可的投资者参与本集合计划；

8. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知投资者。

（二）在如下情况下，管理人可以拒绝或暂停接受投资者的退出申请：

1. 因不可抗力导致管理人无法支付退出款项；

2. 本集合计划涉及的证券期货交易所交易时间非正常停市、份额登记机构、证券登记结算机构或银行结算系统无法正常运作等，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值；

3. 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

4. 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

5. 发生本合同规定的暂停本计划资产估值的情况；

6. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应当及时告知投资者。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

十三、本计划不接受违约退出。

十四、本计划投资运作期间的份额转让

投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的本计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有本计划份额的合格投资者合计不得超过200人。

管理人应当在本计划份额转让前，对受让人的合格投资者身份和本计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本计划的，应当先与管理人、托管人签订资产管理合同。

十五、非交易过户的受理条件与流程

1. 管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指投资者死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指投资者将其持有的计划份额向公益机构转赠，或将其持有的计划份额产生的收益向公益机构转赠。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

十六、资产管理计划份额的冻结与解冻

经人民法院、人民检察院、公安机关及其他有权机构以及资产管理计划份额登记机构认可符合法律法规的其他情况下，本集合计划的资产管理计划份额方可冻结与解冻。当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

十七、管理人以自有资金参与本计划

（一）自有资金参与的条件

在本集合计划初始募集期起始日至集合计划终止日内，管理人可以以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《运作规定》和监管机构的相关规定。

（二）自有资金的参与方式

管理人在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。

（三）自有资金参与的份额比例

自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的16%。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，管理人及其附属机构应当在超标情况发生后的10个交易日内调整自有资金参与份额，并在调整后5个工作日内通过管理人网站公告告知投资者和托管机构，确保符合前述约定。

（四）自有资金的收益分配

管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

（五）自有资金的责任承担

管理人以自有资金所持的本计划份额，与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

（六）自有资金的退出

管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时，应提前 5 个工作日告知投资者和托管人，法律法规、监管规定或自律规则另有规定的除外。集合计划存续期间，管理人有权部分或全部退出自有资金持有份额。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例的，管理人在合理期限内安排自有资金的退出，可不受上述限制。

管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：

（1）管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于相关法律法规、监管机构或自律组织规定的期限时，可与其他投资者同样办理退出业务。

（2）管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的，管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出，以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定时，从其规定。

(3) 法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构报告。

十八、管理人应定期将本计划投资者变更情况报送协会。

第九部分 份额持有人大会及日常机构

所有当事人一致同意，本计划不设置份额持有人大会及日常机构。

第十部分 计划份额的登记

一、资产管理计划的注册登记业务指资产管理计划的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资者资产管理计划账户建立和管理、资产管理计划份额的注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管投资者名册等。

二、本计划的注册登记业务由华鑫证券有限责任公司负责办理。

三、资产管理人委托其他机构代为办理本计划份额登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议。本计划份额登记机构的权限和职责如下：

(一) 注册登记机构享有如下权利：

1. 建立和管理投资者的资产管理计划账户；
2. 取得注册登记费；
3. 保管投资者开户资料、交易资料、投资者名册等；
4. 在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则并依法公告；
5. 法律法规规定的其他权利。

(二) 注册登记机构承担如下义务：

1. 配备足够的专业人员办理资产管理计划的注册登记业务；
2. 严格按照法律法规和资产管理合同规定的条件办理资产管理计划的注册登记业务；
3. 妥善保存登记数据，并将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产

管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于 20 年；

4. 对投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；

5. 按资产管理合同和计划说明书规定为投资者办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；

6. 法律法规规定的其他义务。

四、本计划全体份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将本计划投资者名称、身份信息以及本计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

第十一部分 资产管理计划的投资

一、本资产管理计划的投资目标

管理人将在本合同约定的投资范围内进行投资，力争为计划资产获取稳健回报。

二、本资产管理计划的投资范围及比例

投资范围：

固定收益类及现金管理类资产：国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包含二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、永续债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、项目收益债、金融机构次级债、可转换债券、可交换债券（含非公开发行的可交换债券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、在交易所及银行间市场挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、债券型基金、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款），以及银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司等发行的固定收益类资产管理产品。

本计划投资于其他资产管理产品的，所投资资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

本集合计划不投资于本管理人所设立的资产管理产品。

本集合计划可以依法参与债券回购业务，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。

本计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

投资比例：

1、投资于固定收益类及现金管理类资产的比例不得低过资产管理计划总资产的80%；

2、债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的0-100%。

管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中7个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的10%，按规定限制或暂停退出的情况除外。7个工作日内可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。同时，管理人将安排本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合资产管理计划资产净值的20%。

本计划投资于其他资产管理产品的，计算本集合计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同或同类资产的金额，应符合法律法规的规定及本合同约定。

三、投资比例超限的处理方式及流程

除本合同另有约定外，因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

四、说明 FOF 产品（如是）所投资资产管理产品的选择标准不适用。

五、本资产管理计划的风险收益特征

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为【R2】，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C2-C5】的普通投资者】，具体以销售机构确认的风险等级为准。

本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历或投资经验等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。

六、本资产管理计划的业绩比较基准（如有）

本计划不设业绩比较基准。

七、本资产管理计划的投资策略

1、债券投资策略

本计划将在保持债券组合低波动性的前提下，综合运用多种策略参与市场所提供的投资机会，以期能为投资者获取稳健的收益。

（1）久期配置策略

本计划将在分析中长期经济变化趋势的基础上，预测未来一段时间内利率可能的走向，以此来决定组合久期的长短。预期利率下降时延长组合久期，以获得因债券价格上涨而带来的资本利得；预期利率上升时缩短组合久期，以降低或规避债券价格下跌所带来的风险。

（2）收益率曲线策略

在确定组合久期后，采用收益率曲线分析模型对不同期限债券的风险收益特征进行评估，并根据对收益率曲线形状变化进行预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，来决定本计划资产在长、中、短期债券间的配置比例。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，借以取得较高收益。

（4）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的

债券，随着本计划持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，从而获得资本利得收入。

(5) 信用债投资策略

本计划根据对宏观经济运行周期的研究，综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展前景和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，获取利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。

2、现金管理投资策略

本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

3、证券化资产投资策略

筛选市场上的证券化资产，从主体资质、基础资产、交易结构这三个层次识别风险。主体资质看股东背景、管理团队、资产服务能力、信息系统和风控系统。基础资产是现金流的稳定性和可预测性。交易结构是账户设置、现金流分配顺序、信用触发机制、循环购买机制。获取稳健收益。

4、资产管理产品投资策略

本计划通过对银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的固定收益类资产管理产品的评价，坚持从研究资产管理产品价值入手，按照自上而下和自下而上相结合的原则，悉心选择管理规范、业绩优良的资产管理产品。本计划投资于其他资产管理产品的，所投资资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

八、本资产管理计划的投资决策

1、决策依据

集合计划以国家有关法律、法规、管理人相关制度和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

(1) 《指导意见》、《管理办法》、《业务规范》等有关法律法规、监管规定

及本管理人制度、《资产管理合同》、《说明书》等合同、协议；

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，这是本集合计划投资决策的基础；

(3) 投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。

2、投资决策程序

管理人资产管理业务投资管理实行分级授权管理制度，每一层级的投资决策主体在各自的授权范围内行使相应的职权。具体投资决策程序如下：

资产管理业务相关投资负责人组织各投资经理实施具体投资计划，投资经理定期将所管理产品的投资决策执行和投资运作情况报告私募资产管理业务投资决策小组以及资产管理业务投资决策委员会。

3、投资管理方法

(1) 投资方式：委托财产的具体管理与运用由管理人、投资顾问（如有）、托管行共同完成，并由各方根据资管计划文件和相关合同的规定履行各自的职责。管理人根据投资顾问（如有）的投资建议，通过管理人审查后，进行本资管计划的投资运作，管理人执行投资顾问提供的投资建议，所形成的损失由委托资产承担。

(2) 具体的投资实施：管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定自行进行投资。

(3) 独立的执行：管理人设置独立的集中交易室，通过严格的交易制度和风险监控功能，保证投资经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

九、投资限制和投资禁止

(一) 投资限制

1、投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

2、债券（不包括可转债、可交换债）的公开市场信用评级满足主体评级或债券评级至少有一项需为 AA 级及以上级别（含 AA）；短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，或短期融资券债项评级不低于 A-1；

3、资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）仅限于投资优先级，优先级份额的债项评级为 AA+（含）以上，其基础资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产；

4、集合计划资产总值占资产净值的比例不超过 200%；债券正回购资金余额或债券逆回购资金余额不得超过其净资产的 100%。

5、本计划参与债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过集合计划资产总值，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

6、集合资产管理计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于集合计划资产净值的 10%；

7、本集合计划投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%。

8、相关法律法规、国家政策和本合同约定限制从事的其他投资。

本计划投资于其他资产管理产品的，计算本集合计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应符合法律法规的规定及本合同约定。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，在不改变本集合计划风险收益特征的前提下，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定，在实施前与托管人协商一致并通过公告的方式告知投资者，不需要征求投资者的意见。

（二）投资禁止行为

1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；

3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

4、挪用集合计划资产；

5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

6、使用集合计划资产进行不必要的交易；

7、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；

8、承销证券；

9、向他人贷款或融资提供担保；

10、利用产品为集合计划投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；

11、不得直接投资商业银行信贷资产；不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要

求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

12、不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家产业政策、环保政策禁止投资的行业

或领域（证券市场投资除外）。包括但不限于：

1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；

2) 投资项目违反国家相关环境保护政策要求；

3) 通过穿透核查，最终投向上述投资项目；

13、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

十、本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6个月】。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

十一、本计划存续期间，为规避特定风险，全体投资者同意，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%，如遇此种情形，资产管理人应当在相应类别资产的比例低于计划总资产80%的五个工作日内向资产托管人提供书面说明文件。管理人应详细列明上述相关特定风险。上述相关特定风险包括但不限于以下内容：

(1) 市场风险，指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。

(2) 流动性风险，资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

十二、本计划投资的资产组合的流动性应与参与、退出安排相匹配，本计划开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的10%。本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的20%。本计划流动性安排由管理人负责控制。

第十二部分 投资顾问

本计划不聘请投资顾问。

第十三部分 分级安排

本计划不设分级安排。

第十四部分 利益冲突及关联交易

（一）关联交易及利益冲突情形

投资者在此同意授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他关联交易，将遵循客户利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者并向中国证监会相关派出机构报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。投资者已明确知悉并愿意承担因上述关联交易可能导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。

本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元；管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。

此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

（二）关联交易及利益冲突的应对及处理

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生损害投资者利益的利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合。

第十五部分 投资经理的指定与变更

一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。本计划投资经理与管理人管理的公募基金的基金经理不得相互兼任。

二、本计划的投资经理的资料如下：

本计划的投资经理由【朱婷】、【江理东】担任。

朱婷女士，现任华鑫证券资管固定收益部投资经理，南京大学经济学学士，南京大学产业经济学硕士。曾先后任职于万家共赢资产管理有限公司和天风证券股份有限公司上海证券资产管理分公司，历任基金子公司产品项目经理、券商资管 ABS 团队高级项目经理、券商资管固收产品投资主办人。拥有 7 年资管行业从业经验，对各类资管产品具有深刻的理解，拥有丰富的固定收益投资经验。

取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。

江理东先生，现任华鑫证券资管固定收益部投资经理，上海财经大学资产评估硕士，7 年券商资管投资交易经验，历任国元证券资管交易员、投资经理助理、五矿证券资管投资经理，管理规模超百亿，擅长通过宏观分析和基本面研究挖掘信用债和可转债投资机会。

取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。

三、投资经理离职或因故不能履行其职责时，管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，管理人应及时通知投资者。管理人在其网站上发布公告即视

为履行了向投资者通知的义务。投资经理的选任与变更情况应报中国证券投资基金业协会备案。

第十六部分 资产管理计划的财产

一、资产管理计划财产的保管与处分

(一) 本计划财产的债务由计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

(二) 本计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将本计划财产归入其固有财产。

(三) 管理人、托管人因本计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本计划财产。

(四) 管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。

(五) 本计划财产产生的债权不得与不属于计划财产本身的债务相互抵销。非因本计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对计划财产强制执行。上述债权人对本计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

(六) 证券类资产及证券交易资金的保管

本计划投资形成的证券类资产由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行保管，沪深交易所场内证券交易结算资金由托管人保管。

二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理

托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管账户、证券账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。托管账户名称应当是“资产管理计划名称”，具体以实际开立为准。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付收益均需通过托管账户进行。托管账户的开立和使用，仅限于满足本集合计划开展业务的需要。资产管理计划托管人和资产管理计划管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本集合计划的任何银行账户进行

本集合计划业务以外的活动。

定期存款(包括协议存款)账户的预留印鉴应与托管账户预留印鉴一致,协议存款或定期存款协议中应明确注明存款到期本息应划回托管账户。委托资产投资定期存款,资产管理人应与存款机构签订定期存款协议,该协议作为投资指令附件,该协议中必须有如下明确条款:“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户(明确户名、开户行、账号等),不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款,资产托管人有权拒绝定期存款投资的投资指令。定期存款(包括协议存款)账户开立的存款证实书或存单原件由资产托管人保管。

管理人按照规定开立资产管理计划投资所需其他账户。证券账户和期货账户(如有)的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定,应当是“证券期货经营机构名称—托管人名称—资产管理计划名称”,具体以实际开立为准。托管人应在资产管理计划成立前将托管账户信息以邮件等书面方式通知管理人。资产管理计划财产进入银行间债券市场开展投资前,管理人应提前通知托管人,提供所需资料,由托管人以资产管理计划名义向银行间市场登记结算机构申请开立债券托管账户和资金结算账户(DVP账户)。管理人负责以本计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表本计划进行交易。当本合同项下托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时,托管人按照有权机关要求依法予以执行,因此影响托管账户资金划付的,托管人不负任何责任。冻结或扣划相关手续办理完毕后,托管人应根据业务需要通知管理人,但法律法规或监管要求另有规定的除外。

第十七部分 投资指令的发送、确认和执行

(一) 交易清算授权

1、集合计划管理人应当事先向集合计划托管人发出书面通知,载明集合计划管理人有权发送指令的人员名单(以下称“指令发送人员”)及各个人员的权限范围、授权生效日期、预留印鉴和授权人签字样本,集合计划管理人应向集合计划托管人提供预留印鉴和指令发送人员的签字样本。若资产管理人同时向资产托管人出具了资产管理业务统一交易清算授权书和单个资管计划交易清算授权书的,授权书以以下第(2)种方式为准:(1)统一授权书。(2)单个资管计划授权书。

2、集合计划管理人向集合计划托管人发出的授权通知应加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人以传真或电子邮件方式向托管人发送授权通知书。管理人向托管人发出授权通知后，需向托管人电话确认授权通知已收妥传真件或扫描件。授权通知自其载明授权的起始日期或管理人电话确认托管人已收妥的日期中较晚之日起生效。

3、集合计划管理人和集合计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

（二）投资指令的内容

投资指令是集合计划管理人在运作集合计划资产时，向集合计划托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。相关登记结算公司向集合计划托管人发送的结算通知视为集合计划管理人向集合计划托管人发出的指令。

（三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序

1、投资指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表集合计划管理人用电子邮件、传真的方式或其它管理人和托管人双方确认的方式向集合计划托管人发送(管理人的传真号码为 021-54967280，邮箱地址为 qiuwq@cfsc.com.cn、liqx@cfsc.com.cn、gaoxy@cfsc.com.cn、luowj@cfsc.com.cn、lilt@cfsc.com.cn、zangxy@cfsc.com.cn，托管人只接受此传真号码/邮箱的划款指令。若管理人传真号码/邮箱地址变更，应提前一个工作日以书面形式告知托管人，并且获得托管行确认开始生效)。集合计划托管人依照“授权通知”中的预留印鉴样本及签字（章）样本对指令上的印鉴/签字进行一致性审核，审核无误的方可执行指令。对于指令发送人员发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。但如果集合计划管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，且管理人已经以传真、邮件或其他双方认可的形式通知集合计划托管人并获得托管人确认，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，集合计划管理人不承担责任。如集合计划管理人撤销或更改发送至集合计划托管人时，集合计划托管人已经执行了撤销或更改之前的指令，则集合计划托管人不承担责任。

2、集合计划管理人应按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，集合计划管理人应及时电话通知集合计划托管人清算岗位。

集合计划托管人应在收到指令后复核并执行，不得延误，对于当日 15:00 之后收到的指令，托管人应尽力在指定时间内完成资金划拨，但不承担执行失败的责任。集合计划托管人发现集合计划管理人的指令违法、违规或违反《集合资产管理合同》约定的，有权不予执行，并及时书面通知集合计划管理人。

集合计划管理人在发送指令时，应为集合计划托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。指令传输不及时未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行所造成的损失由集合计划管理人承担。若托管人因投资监督需要要求管理人发送相关交易解释、说明等文件，则视托管人收到上述有效文件时间为收到投资指令时间。相关说明文件包括但不限于：

- (1) 投资交易或资金用途说明文件；
- (2) 收款账户信息证明文件；
- (3) 其他文件资料（如需）。

管理人应保证以上所提供的作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；托管人对此类文件资料仅做一致性审查。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失，责任由管理人承担。

3、本协议项下的托管账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由托管人直接从托管账户中扣划，无须管理人出具划款指令。

托管人在收到有效指令后，将对于同一批次的划款指令随机执行，如有特殊支付顺序，管理人应以书面或其他双方认可的形式提前告知。

托管人依据本合同约定正确执行管理人的合法划款指令，对委托财产发生的损失，不承担任何形式的责任。

指令若为以数据接口方式发出的电子指令，则以托管人收到的电子指令为准。

（四）托管人依法暂缓、拒绝执行投资指令的情形处理程序

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规规定或《资产管理合同》约定的，应立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，暂停投资指令的执行并要求管理人重新发送修改后的投资指令。托管人可以要求管理人通过电子邮件或传真的方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断投资指令的有效性。管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因

管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失，由管理人承担责任。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字/章。如集合计划管理人撤销或更改已发送至集合计划托管人的指令时，集合计划托管人已经执行了撤销或更改之前的指令，则集合计划托管人不承担责任。

对于管理人的有效指令和通知，除非违反本合同约定或有关法律法规的规定或具有本章第（四）项和第（五）项所述错误，托管人不得无故拒绝或拖延执行，否则应就资产管理计划或管理人由此产生的损失负赔偿责任。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等，未按照本合同约定的传真号码、邮箱地址且未通过书面形式通知生效或双方认可的其他形式发送划款指令。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

（六）更换投资指令被授权人的程序

集合计划管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前1个工作日通知集合计划托管人；修改授权通知的文件应由集合计划管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。集合计划管理人对授权通知的修改应当以电子邮件或传真的形式发送给集合计划托管人，同时电话通知集合计划托管人，授权通知的修改自其载明授权的起始日期或管理人电话确认托管人已收妥的日期中较晚之日起生效。

（七）授权通知书及投资指令的保管

授权通知书及投资指令以传真、电子邮件形式发送托管人，原件由管理人保管，托管人保管传真件/扫描件，若传真件/扫描件与原件不一致的，以托管人收到的传真件/扫描件为准。

（八）其它事项

1、集合计划托管人在接收指令时，应对投资指令的印鉴和被授权人是否与预留的授权文件内容相符做一致性审慎检查，如发现问题，应及时通知集合计划管理人。除前述一致性审核检查外，集合计划托管人不负责审查投资指令的真实性。

2、除因故意或过失致使集合计划的利益受到损害而负赔偿责任外，集合计划托管人对执行集合计划管理人合法指令对集合计划财产造成的损失不承担赔偿责任。集合计划托管人因正确执行集合计划管理人投资指令而产生的相关法律责任，由集合计划管理人承担，集合计划托管人不承担该责任。集合计划托管人因未正确执行集合计划管理人符合法律法规规定及《集合资产管理合同》约定的指令而使集合计划的利益受到损害或产生的相关法律责任，由集合计划托管人承担，集合计划管理人不承担该责任。

3、集合计划管理人向集合计划托管人下达指令时，集合计划管理人应确保集合计划银行托管账户有足够的资金余额，对超头寸的投资指令，集合计划托管人在履行及时通知义务但管理人未采取措施情况下可不予执行，由此造成的损失，由集合计划管理人负责赔偿。

4、对于可能存在管理人由于管理原因、内部道德风险导致发出的指令，如托管人复核与授权文件内容相符，应由管理人承担全部责任，管理人不得以不知情、相关人员犯罪、不是真实意思表示为由，主张划款指令无效或者要求托管人承担赔偿责任。

第十八部分 越权交易的界定

一、越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下计划份额持有人的授权而进行的投资交易行为。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

二、越权交易的处理程序

（一）违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规

定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告监管机构。

托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告监管机构。

管理人应向计划份额持有人和托管人主动报告越权交易。在限期内，计划份额持有人和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对计划份额持有人和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告监管机构。

（二）越权交易的例外

非因管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标：

（1）由于管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形（包括但不限于证券市场波动、上市公司或发行人合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到监管机关处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定），为被动超标，不属于越权交易。发生上述情形时，管理人应在发生超标涉及的相关资产可出售、可转让或可交易之日起的15个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求，法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。

（三）越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本计划财产所有。

三、托管人对管理人投资运作的监督

（一）托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：

1. 对本资管计划以下投资范围进行监督：

固定收益类及现金管理类资产：国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包含二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、永续债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、项目收益债、金融机构次级债、可转换债券、可交换债券（含非公开发行的可交换债券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、在交易所及银行间市场挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、债券型基金、同业存单、债券逆回购、货币市场

基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款），以及银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司等发行的固定收益类资产管理产品。

本集合计划不投资于本管理人所设立的资产管理产品。

本集合计划可以依法参与债券回购业务。

2. 对本资管计划以下投资比例限制进行监督：

（1）投资比例

1、投资于固定收益类及现金管理类资产的比例不得低过资产管理计划总资产的80%；

2、债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的0-100%。

（2）投资限制

1、投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的25%；资产管理人的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

2、债券（不包括可转债、可交换债）的公开市场信用评级满足主体评级或债券评级至少有一项需为AA级及以上级别（含AA）；短期融资券发行人主体评级不得低于AA，或短期融资券债项评级不低于A-1；

3、资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）仅限于投资优先级，优先级份额的债项评级为AA+（含）以上，其基础资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产；

4、集合计划资产总值占资产净值的比例不超过200%；债券正回购资金余额或债券逆回购资金余额不得超过其净资产的100%。

5、本计划参与债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过集合计划资产总值，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

6、集合资产管理计划开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于集合计划资产净值的10%；

7、本集合计划投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的20%。

8、相关法律法规、国家政策和本合同约定限制从事的其他投资。

(二) 托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内, 对本计划的直接投资履行监督职能。

(三) 管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供履行投资监督所需的数据和信息, 托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

(四) 如需托管人对本计划关联交易进行监督的, 管理人应于合同生效前提供关联方名单, 并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息, 导致托管人无法及时对关联方证券进行监督, 由过错方承担相应责任。

(五) 管理人与托管人应提供各自关联方名单, 在合同期限内根据变化应及时更新关联方名单, 并以书面形式告知。由于托管人或管理人未提供或未及时更新关联方名单导致资产管理计划遭受损失的, 由过错方承担相应责任。

(六) 托管人对“投资限制”中“管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金, 不得超过该资产的 25%”的监督仅限于管理人托管在托管人处的全部集合计划。

(七) 如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的, 各方除履行必要的合同变更流程外, 还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

第十九部分 资产管理计划财产的估值和会计核算

一、估值目的

资产管理计划财产估值的目的是客观、准确地反映计划资产的价值, 依据经计划资产估值后确定的计划资产净值计算资产管理计划份额净值, 是计算计划参与和退出价格的基础。

二、估值时间

资产管理人在每个交易日对计划财产进行估值, T+1 日内完成 T 日估值, 并于当日通过电子直连或双方均认可的方式与托管人对估值表进行核对。估值原则应符合本合同及其他法律法规的规定。

三、估值方法

估值坚持公允价值计量，符合本合同、《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及其他法律、法规、自律组织的规定，应当按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的规定，对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

估值的基本原则：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化且证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并通过定期校验，确保估值技术的有效性。

(3) 有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，资产管理人应根据具体情况与托管人进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

投资固定收益品种的估值方法

本节所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、商业银行金融债、可转换债

券、中小企业私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券品种。

1、交易所市场交易品种估值处理

(1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券(票据)、私募债券、永续债、次级债、二级资本债，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值；未公开发行上市的资产支持证券(票据)、私募债券、永续债、次级债、二级资本债，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本法估值。管理人向托管人发送产品分类，托管人根据管理人的认定进行估值。

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本法估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、银行间市场交易品种估值处理

(1) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方机构未提供估值价格的，按成本估值。

5、同一债券在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

6、证券投资基金估值方法

1)、持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算；估值日前一交易日基金每万份收益无公布的，按此前最近交易日的每万份收益估值。

3) 场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第1条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第2条规定的方法估值。

4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

5) 私募投资基金，按估值日的份额净值估值，若估值日私募基金未公布份额净值，按最近公布的份额净值估值。

商业银行理财计划、信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、基金及基金子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、券商资管及其子公司资产管理计划、私募基金等按照估值日的份额净值估值，估值日未公布份额净值的，以前最近一次公布的份额净值计算。无法提供净值，按成本估值。管理人向托管

人提供以上资产的份额净值，托管人据此估值。

7、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，如有差额，不做追溯调整；

8、逆回购以成本列示，按照预期收益率逐日计提利息。

9、管理人采用上述估值方法对固定收益品种进行估值，应被认为采用了适当的估值方法，但是如果管理人认为上述估值方法不能客观反应其公允价值的，管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，管理人可以根据具体情况与托管人商定后，按最能反应其公允价值的价格估值。

(4) 相关法律法规以及监管部门有强制规定，从其规定，如有新增事项，按国家最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站公告告知投资者。

(5) 当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。

(6) 如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益的时候，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

(7) 根据相关法律法规，集合计划进行资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担，本集合计划的会计责任方由管理人承担，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

(8) 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

四、估值对象

本计划财产项下所有的股票、权证、债券、基金、期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

五、估值程序

(一) 本计划份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由本计划财产承担。国家另有规定的，从其规定。

(二) 管理人在每个交易日对计划财产进行估值, 集合计划资产净值由资产管理人 T+1 日内 (T 为估值日) 负责计算, 资产托管人复核完成。估值原则应符合本合同及其他法律、法规的规定。

(三) 本计划财产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此, 就与本计划财产有关的会计问题, 会计责任方是管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致意见, 以管理人对本计划财产净值的计算结果为准。

六、估值错误的处理

(一) 管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保本计划财产估值的准确性、及时性。估值错误偏差达到集合计划资产净值的 0.5% 时, 视为估值错误。集合计划管理人应当立即通报计划托管人, 并向投资者披露。

(二) 估值错误的处理原则和方法

1. 估值错误处理原则

估值错误已发生, 但尚未给当事人造成损失时, 差错责任方应及时协调各方, 及时进行更正, 因更正差错发生的费用由差错责任方承担; 由于差错责任方未及时更正已产生的差错, 给当事人造成损失的, 由差错责任方对直接损失承担赔偿责任; 若差错责任方已经积极协调, 并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正, 则后者应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认, 确保差错已得到更正。

2. 估值错误的处理方法

(1) 管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认, 但因资产估值错误给计划份额持有人造成损失的, 由管理人与托管人按照过错各自承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时, 管理人应当立即纠正, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 如管理人和托管人对资产管理计划净值的计算结果, 虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时, 为避免不能按时披露资产管理计划净值的情形, 以管理人的计算结果对外披露, 由此给投资者和计划造成的损失, 托管人予以免责。

(3) 由于一方当事人提供的信息错误, 另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误, 进而导致资产管理计划净值计算错误造成投资者的损失, 以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失, 由提供

错误信息的当事人一方负责赔偿。

(4) 管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

七、估值调整的情形与处理

(一) 管理人作为估值的第一责任人，应定期评估第三方估值机构的估值质量，并对估值价格进行检验，防范可能出现的估值偏差。当出现投资品估值偏差，估值机构发布的估值不能体现公允价值时，管理人应综合第三方估值机构估值结果，经与托管人协商，谨慎确定公允价值，并按相关法规的规定，发布相关公告，充分披露确定公允价值的方法、相关估值结果等信息。

(二) 如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法进行估值不能客观反映本计划公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

八、暂停估值的情形

(一) 与本资产管理计划投资有关的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(二) 因不可抗力或其它情形致使管理人、托管人无法准确评估计划财产价值时；

(三) 占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；

(四) 如出现管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致管理人不能出售或评估计划财产的；

(五) 中国证监会和本合同认定的其它情形。

九、资产管理计划份额净值的确认

计划财产净值和计划份额净值由管理人负责计算，管理人和托管人于每日按照双方约定的方式进行核对确认。

十、特殊情况的处理

(一) 管理人或托管人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。

(二) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现该错误的,由此造成的计划财产估值错误,管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十一、资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策比照现行政策并按照本资产管理合同约定执行:

- (一) 资产管理人为计划财产的会计责任方;
- (二) 计划财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日;
- (三) 计划财产的会计核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;
- (四) 会计制度执行国家有关的会计制度;
- (五) 本计划财产独立建帐、独立核算;
- (六) 资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制计划财产会计报表;
- (七) 托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

第二十部分 资产管理计划的费用与税收

一、资产管理计划的费用种类

- (一) 资产管理人的管理费;
- (二) 资产托管人的托管费;
- (三) 资产管理人依据本合同收取的业绩报酬;
- (四) 本计划运营过程中发生的增值税等税费以及与缴纳税收有关的手续费、汇款费等;
- (五) 计划财产划拨支付的银行结算费用、证券、期货(如有)等账户的开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用;
- (六) 计划财产的证券、期货(如有)等证券投资交易费用、注册登记费用、会计师费、审计费;

(七) 本合同生效后与本计划有关的会计师费和律师费及为实现本计划权益、债权而支付的所有相关费用，包括但不限于诉讼费、律师费、仲裁费、律师差旅费、执行费、财产保全费及其他实现债权所产生的费用等（如有）。

(八) 资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用（如有）。

(九) 按照法律法规及本合同约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式

(一) 资产管理人的管理费

在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【0.6】%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为【0.6】%

H 为每日应计提的资产管理计划管理费

E 为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划管理费自计划成立日起，每日计提，按季支付。由资产管理人向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令，经资产托管人复核后于下一季度首日起3个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

管理费收取账户信息：

户 名：华鑫证券有限责任公司

帐 号：0764152322000913

开户银行：上海浦东发展银行徐汇支行

(二) 资产托管人的托管费

在通常情况下，资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.01】%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为【0.01】%

H 为每日应计提的资产管理计划托管费

E 为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划托管费自计划成立日起，每日计提，按季支付。由资产管理人向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令，经资产托管人复核后于下一季度首日起3个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人，若遇法定节假日、

休息日，支付日期顺延。管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的，托管人有权在托管费支付日当日或后续任一日自行扣收全部或部分应付未付托管费。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

托管费收费账户信息：

账户名：资产托管费

开户行：上海银行市南分行

账号：PL52613

（三）业绩报酬

本集合计划不收取业绩报酬。

（四）税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者应缴纳的税收由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

为免歧义，各方特别约定并优先使用如下条款：本合同各方特别约定，如依据相关法律法规或财政税务主管部门的规定，就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为及其他应税行为，属于本计划需要承担且由管理人作为纳税主体缴纳的，该税费由计划财产承担，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意（除本约定外，本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳的，相关方应自行缴纳）；管理人在向投资者交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求缴纳相应税费（具体以管理人通知为准），管理人亦有权以计划剩余财产直接缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。如管理人因此垫付相应税费等款项的，管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项，投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意，计划财产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

（五）证券交易费用

本集合计划应按规定比例在发生投资交易时单独计提并分别支付经手费、证管费、过户费、印花税和证券结算风险基金等，作为各自交易成本直接扣除。交易佣金的费率由集合计划管理人本着保护投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金，其费率由管理人根据有关政策法规确定。具体划款时间和金额以管理人划款指令为准。

证券账户开户费由管理人在开户时先行垫付，在集合计划成立后，管理人出具指令，由托管人从集合计划中扣划至管理人指定账户。托管人不垫付证券账户开户费。

（六）与本集合计划相关的审计费

本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，进行摊销。若产品当年终止，当年审计费在终止日按审计费金额据实调整。

（七）其他费用：

银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册登记机构相关费用（包括认购登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费）等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用，一次计入集合计划费用；开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用。

本资产管理计划存续期间发生的其他项费用由托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用。

（八）不得列入资产管理计划财产费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在计划资产中列支。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

（九）费率的调整

管理人和托管人可根据市场发展情况按照本合同约定的程序，调整资产管理费率、资产托管费率及业绩报酬计提水平。

管理人可以调减管理费率，并在新的管理费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。

管理人、托管人可以协商调减托管费率，并在新的托管费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。

第二十一部分 资产管理计划的收益分配

一、资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。

二、可供分配利润的构成

- 1、银行存款利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、金融产品收益；
- 4、已实现的其他合法收入。

集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定及本合同、集合计划说明书规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

三、收益分配原则

1 本集合计划的每一份额享有同等收益分配权；

2、集合计划存续期间，T日参与的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；T日退出的计划份额享有当日分红权益，自下一工作日起不享有分红权益；

3、本集合计划的收益分配方式为红利再投资，“每日分配，按日支付”。本集合计划根据每日收益情况，以每万份收益为基准，以人民币元方式簿记，为委托人每日计算当日收益并全部分配，按日支付且结转为相应的集合计划份额，投资者可通过退出计划份额获得现金收益。委托人当日收益分配的计算保留到小数点后2位。

4、法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

四、收益分配的方式

本集合计划按日计算并分配收益，支付给投资者若实际收益为负值，管理人将相应缩减投资者份额。投资者可通过退出集合计划份额获得现金收益。管理人不另行公告收益分配方案。管理人于每个开放日公告前一个开放日的每万份收益和七日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个工作日，披露节假日期间的每万份收益和七日年化收益率，以及节假日后首个开放日的每万份收益和七日年化收益率。法律另有规定的，从其规定。

每万份收益和七日年化收益率的计算公式如下：

每万份收益 = (当日集合计划净收益 / 当日集合计划总份额) * 10000

其中， R_i 为最近第 i 个公历日 ($i=1, 2, \dots, 7$) 的集合计划的每万份收益。

每万份收益的计算保留到小数点后 4 位，七日年化收益率的计算保留到小数点后 3 位。

五、收益分配中发生的费用

计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，计划登记机构可将计划份额持有人的现金红利自动转为计划份额。

第二十二部分 信息披露与报告

一、管理人应向投资者提供下列信息披露文件：

- (一) 资产管理合同、计划说明书和风险揭示书；
- (二) 资产管理计划净值，资产管理计划参与、退出价格；
- (三) 资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；
- (四) 重大事项的临时报告；
- (五) 资产管理计划清算报告；
- (六) 中国证监会规定的其他事项。

二、资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息：

(一) 净值报告

投资标准化资产的资产管理计划成立后，资产管理人每周将经资产托管人复核的上周最后一个交易日的计划财产净值向投资者披露。

(二) 季度报告和年度报告

1. 管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告，每年度结束之日起四个月内披露年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制当期的季度报告和年度报告。

2. 管理人、托管人在每年度分别提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站披露。集合计划成立不足 3 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。

年度报告内容应包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基础、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

3. 季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

4. 资产管理计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》相关规定的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

（三）托管人履职报告

1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2. 管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

3. 管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

4. 因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

三、临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起五个工作日内以管理人网站公告方式及时向投资者披露（其中第六条严重违法违规发生之日起两个工作日内）。临时报告的情形包括但不限于：

（一）集合计划运作过程中，投资经理、投资顾问（如有）发生变动，以及其他出现可能对集合计划的持续运作、投资者利益、资产净值产生重大影响的事项。

（二）发生巨额退出并延期支付、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的。

（三）集合计划合同的变更、展期、终止与清算。

（四）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。

（五）集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券。

（六）管理人、托管人因严重违法违规，被中国证监会取消相关业务资格。

（七）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。

（八）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。

（九）其他管理人认为的重大事项。

管理人向投资者提供的信息披露文件，应当及时报送中国证监会相关派出机构或证券投资基金业协会，具体的报送时间、方式及途径以中国证监会相关派出机构或证券投资基金业协会等监管机构规定的为准。若中国证券投资基金业协会等金融监管部门对资产管理计划信息披露规定进行修订或/和更新，则本集合计划的信息披露事项约定以金融监管部门修订或/和更新后的规定为准。

四、向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式

（一）投资者信息查询范围

投资者可根据本合同约定的时间和方式查阅或复制计划所披露的信息资料。

（二）投资者向管理人查询信息的方式

管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了告知义务，投资者可通过以下方式向管理人查阅本合同约定披露的信息资料：

1. 资产管理人网站

定期报告、份额净值报告、临时报告等本合同约定披露的信息资料将在管理人

网站上披露，投资者可随时查阅。

2. 管理人、销售机构指定营业网点查询

本计划《说明书》、《资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人和集合计划销售机构的住所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人保证其提供的内容与所披露的内容完全一致。

3. 管理人客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，投资者可以通过管理人客服电话（95323）查询。

五、管理人、托管人向监管机构的报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报送中国证监会相关派出机构。

第二十三部分 风险揭示

投资者投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致投资者本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。本集合计划面临的风险包括但不限于以下风险：

一、资产管理计划面临的一般风险

本集合计划的主要风险因素为本金损失风险、市场风险、流动性风险、管理风险、合规性风险、信用风险、操作风险、合同变更风险、电子合同签约风险、对账单风险、份额转让风险、募集失败风险、税收风险、关联交易风险、其它风险，本集合计划管理人提醒投资者注意本集合计划的相关风险并对风险采取了对应的防范措施。具体风险揭示如下：

（一）本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，但不保证计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为【R2】，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C2-C5】的普通投资者】。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

（二）市场风险

本计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

（三）管理风险

本计划运作过程中，管理人依据本合同约定管理和运用计划财产所产生的风险，由计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

（四）流动性风险

本计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

（五）信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险，包括：

（1）债务人违约风险

如遇金融产品发行主体信用状况恶化、信用评级下降，可能导致金融产品价格下降进而影响资产管理计划财产收益水平，若出现到期不能履行合约进行兑付的情形，可能使投资者遭受本金损失。

（2）交易对手方违约风险

当本计划交易对手违约时，将直接导致委托资产损失，或导致资产管理计划不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

（3）本集合计划投资资产中可能包含中低评级信用债品种，其信用风险可能大大高于国债和高评级信用债品种，存在因所投品种未按时足额兑付，给投资者带来

大额损失的可能性。如本集合计划所投资的债权类品种中的一个或多个出现因流动性匮乏等原因无法按时变现，或因信用恶化出现发行人延迟或无法按时足额还本付息，截至集合计划终止清算前仍未处置完成的情况（此类资产下称：未能流通变现资产），投资者、托管人在此一致同意并授权管理人可按如下原则处置：终止清算时，对于已变现的资产首先向投资者分配，对上述未能流通变现资产，按延期清算原则进行清算并分配。

（六）合规性风险

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及《管理合同》有关规定的风险。

（七）操作风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等所引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

（八）合同变更风险

1、资产管理合同的变更

(1)各方书面一致同意，以下事项可由管理人自行决定变更：

- A. 调低管理人的报酬标准；
- B. 调低参与费、退出费的费率；
- C. 投资经理的变更；
- D. 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

(2)各方书面一致同意，以下事项可由管理人和托管人协商后变更：

- A. 调低托管人的报酬标准；
- B. 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效；

C. 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

(3) 除前文第 1 项、第 2 项所述之外的其余事项如需发生变更的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后 5 个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在临时开放期做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。

如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）约定的日期开始生效，对合同各方均具有法律效力。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者和托管人同意，并履行合同变更程序。

特别约定：在本集合计划投资者人数少于 3 名（含 3 名）的情况下，经全体投资者、管理人、托管人同意，也可通过签署补充协议的方式进行合同变更，采用该等方式变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。

2、发生下列事项时，应由承接的管理人或托管人承接合同相应的权利与义务，并按本合同相关条款进行变更程序：

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。发生此等情形时，原管理人应当向新的管理人交接本资产管理计划资产管理事务。

(2) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接。发生此等情形时，原托管人应当向新的托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

3、全体投资者、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后，也可对本合同内

容进行变更，但资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。

4、合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

5、投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

6、本合同对应的托管协议是指《华鑫证券有限责任公司集合资产管理计划之资产托管协议》（以实际签署为准）。本计划托管人为上海银行股份有限公司，托管人根据本合同和《托管协议》的约定履行托管职责。如两者存在不一致的，则以本合同约定为准。

7、本合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案。

（九）电子合同签约风险

本集合计划可采用经中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式，同所有网上交易一样存在操作的风险。

（十）对账单风险

管理人根据投资者要求可使用邮寄对账单等方式，可能由于投资者提供的联系信息不准确，或者快递途中丢失，导致无法正常获得对账单信息。采用邮寄方式的，对账单自邮局寄出即视为送达。

（十一）份额转让风险

本计划成立后，投资者可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。投资者通过交易平台转让份额需自行寻找受让方，份额转让价格由投资者与受让方协商确定，产生的转让费用由投资者自行承担，投资者份额转让价格与集合计划份额净值可能不一致。

（十二）募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。在发生募集失败时，管理人的责任承担方式如下：

1. 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
2. 在本计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资

者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

（十三）税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

二、资产管理计划面临的特定风险

（一）无法提前退出的风险

本集合计划份额定期开放，投资者只能于本集合计划退出日办理份额退出，其他时间投资者面临无法提前退出的风险。

（二）业绩报酬计提基准不能达到的风险

本集合计划公布的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的依据，不代表预期收益率，也不是管理人向投资者保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资者的投资可能出现达不到业绩报酬计提基准或本金受损的风险。

（三）集合计划份额延期的风险

当集合计划的管理期限届满时，如集合计划所投资的资产未全部变现，集合计划可能面临延期至投资资产全部变现之日，相应投资者可能面临份额延期的风险。

（四）资金前端控制产生的风险

根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，管理人应控制在交易所实施竞价交易且为净额担保结算的交易品种的全天净买入金额，在极端情况下，可能因相关交易单元买入申报金额不符合资金前端控制额度限制而导致买入申报被拒绝。

（五）资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理合同是基于中国基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，如本计划的投资范围、产品结构等存在特殊约定而无法完全适用中国基金业协会发布的合同指引或者本合同存在与正式稿不一致的，虽然管理人将在本风险揭示书中进行特别揭示，并在资产管理合同报送中国基金业协会备案时出具书面说明，但仍可能因该等特殊约定与中国基金业协会合同指引不一致，对投资者权益造成影响。

（六）资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划可能面临管理人未能完成在基金业协会备案手续或迟延完成备案手续，从而导致本计划无法投资或迟延投资，给投资者造成损失的风险。

（七）委托募集的风险

本计划的销售机构包括华鑫证券有限责任公司。销售机构应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地履行说明义务、反洗钱义务、承担特定对象确定、投资者适当性审查、资产管理计划推介及合格投资者确认等相关责任以及资产管理计划销售协议中约定的其他义务。如销售机构未能完全履行该等义务，将影响资产管理计划募集环节的合规有序开展，从而可能会导致本资产管理计划以及资产管理计划投资者受到一定损失。若资产管理计划销售机构的销售系统出现故障或资产管理计划销售人员存在操作失误，也可能对本资产管理计划以及资产管理计划投资者造成不利影响。在其他销售机构代理推广本集合计划时，管理人将应属本机构负责募集事项委托其他机构办理，因其他销售机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。

（八）集合计划提前终止或展期的风险

管理人根据本集合计划实际运作情况，有权提前终止本集合计划；符合展期条件的，管理人、托管方、同意展期投资者将签署书面协议进行展期，管理人将为不同意展期的投资者办理退出事项。集合计划存续期限的变动可能给投资者带来一定风险。

（九）投资标的的风险

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

（1）投资公募基金的特定风险

1) 信用风险：因公募基金的管理人未按投资合同的约定履行兑付义务而导致的风险。

2) 市场风险：因宏观政策、经济周期、市场价格等因素的变化，导致计划投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

3) 操作风险：在计划投资管理过程中，由于不完善或有问题的程序和不适当的管理措施，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

4) 流动性风险

因公募基金经理人发行的交收规则或者设置单一客户巨额赎回、巨额赎回规则等，导致持有的基金不能迅速、低成本地转变为现金的风险。

5) 估值风险

由于基金份额净值当日开市时不能获取数据，只能参考前一期份额净值，对于计划估值及风险控制均有滞后作用，影响管理人的投资判断，从而影响计划的投资收益。

6) 不可抗力风险：因发生投资者或受托人不能预见、不能避免和不能克服的客观情况，导致计划投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

7) 其他风险：是指除上述风险外，所有导致计划投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

8) 分级基金 B 份额持有人的特有风险：由于分级基金 B 份额具有高杠杆特性，呈现出预期风险高，预期收益高的特征，在标的指数持续下跌的市场环境下，分级基金 B 份额的价格杠杆倍数一般会增加；而在标的指数持续上涨的市场环境下，分级基金 B 份额的价格杠杆倍数一般会下降。因此分级基金 B 份额的持有人会因价格杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

(2) 城投债的特别风险

本集合计划可能投资于城投债，城投债包含如下风险：

1) 宏观经济波动风险：城投公司的基础设施建设、土地开发、保障房等业务板块受宏观环境影响大，如果出现较大的经济波动，会对基础设施投资造成较大影响，进而可能对城投公司的经营状况及盈利能力都会造成较大影响，对城投公司而言存在一定的宏观经济波动风险。

2) 财政收入波动风险：城投公司的主营业务收入主要来自政府对其从事委托代建业务所进行的补偿，当地财政收入的状况直接影响财政对发行人的补偿能力。如果城投公司所在地的财政收入出现大幅下跌，城投公司自身将面临财政收入波动带来的补贴下滑的风险。城投公司所从事的基础设施代建项目也可能面临政府回款不及时或不规范的风险。

3) 土地价格波动风险：城投公司存货中土地占比较高，未来土地价格尤其是二、三线城市土地价格存在进一步下跌的可能，对于城投公司所拥有的大量土地存货应关注土地

4) 价格波动风险，可能存在资产减值风险。

5) 融资平台政策变化风险：监管政策变动可能对城投公司生产、经营以及投融资活动产生的风险。

6) 财政补贴风险：城投公司盈利水平较弱，依赖地方政府的财政补贴收入，未来随着地方政府财力的弱化和平台公司职能定位更加市场化，政府补贴政策可能会调整，需要关注政府补贴发放不及时或减少给城投公司带来的压力。

7) 业务定位转型和资产划拨风险：城投公司主要在政府指导下从事基础设施建设职能，未来随着当地经济发展规划和平台公司定位的调整，城投公司的主营业务范围可能会发生调整，旗下资产业务甚至存在整合划转的可能。需要关注未来平台公司业务定位转型和资产划拨的风险。

(3) 正回购风险

本计划投资范围包括债券正回购，从事债券正回购存在着包括但不限于以下风险：

1) 价格风险：是指由于债券交易价格不设涨跌停幅度限制，可能发生债券交易价格剧烈波动，存在亏损的可能，可能由此造成损失；

2) 套利风险：是指由于债券价格偏离预期，债券正回购和现券交易的组合套利过程中存在亏损的可能，可能由此造成损失；

3) 交收风险：是指债券正回购交易到期后存在无法完全履行交收责任的可能性，可能由此造成损失；

4) 质押风险：是指由于交易所、登记公司债券质押式回购交易标准券折算比例的调整，可能导致债券欠库，可能由此造成损失；

5) 结算风险：根据证券登记结算公司的业务规则以及关于结算风险管理的相关规定，在债券正回购的结算过程中，证券登记结算公司有可能依照有关业务规则或约定处置质押券，可能由此造成损失。

(4) 投资资产支持证券（ABS/ABN）的特有风险

1) 交易结构风险：若发起人的资产出售是作为资产负债表内融资处理，则当发

起人破产时，其他债权人对证券化资产仍享有追索权，从而导致资产支持证券的投资者面临本息损失的风险。

2) 信用风险：也称为违约风险。由于资产支持证券的信用链结构，投资者可能面临资产证券化参与主体违背合约的风险。在资产支持证券合约到期之前或在可接受的替代方接任之前，任何参与主体对合约规定职责的放弃，都会给投资者带来损失的风险。

3) 提前偿还风险：资产支持证券一般有提前偿还条款，发行人有权在债券到期前提前偿还全部或部分债券，可能使得投资者在现金流的时间管理上面临不确定性，同时面临再投资风险。

(5) 次级债的投资风险

1) 次级性风险：次级债券本金和利息的清偿顺序在发行人的普通债之后、先于发行人的股权资本，存在次级性风险。

2) 利率风险：受国民经济总体运行状况、国家宏观货币政策财等因素的影响，市场利率水平和结构存在波动可能性从而对次级债的投资收益产生影响。

3) 流动性风险：证券公司次级债采用非公开发行的形式，向不超过 200 名特定对象发行，发行结束后在交易所固定收益平台转让，在债券到期之前只能在有限的投资者之间进行转让。在上述要求下，证券公司次级债具有一定的流动性风险，投资证券公司次级债可能存在无法随时并足额转让的风险。

4) 偿付风险：在次级债持有期间，如发行人公司所处的宏观经济环境、行业政策和资本市场状况等外部因素发生变化，加上公司本身生产经营中存在的确定性，可能导致公司不能从预期的还款来源中获得足够的资金，从而影响公司按期偿付本期债券本息的能力，使投资者面临一定的偿付风险。

(6) 投资现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等）、货币市场基金和交易所、银行间市场逆回购等标准资产等的风险。

1) 法律与政策风险：因国家政策及相关法律、法规的调整与变化，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

2) 信用风险：因融资人未按同业存款合同的约定履行还款义务而导致的风险。

3) 市场风险：因宏观政策、经济周期、市场价格等因素的变化，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

4) 操作风险：在同业存款的发放与管理过程中，非因管理人原因（不可抗力除外）产生的不完善或有问题的程序和不适当的管理措施，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

5) 承担相关法律费用的风险：根据同业存款合同约定采取诉讼或仲裁等相应措施收回本息时，如需委托他人代为诉讼或仲裁，投资者可能将承担相应实现存单收益的费用，包括但不限于诉讼（仲裁）费、律师费、诉讼差旅费、律师差旅费、执行费、保全费及其他实现存单收益的必要费用，从而带来风险。

（7）投资国债、地方政府债、中央银行票据等利率债券的风险

1) 利率风险：利率风险是指利率的变动导致债券价格与收益率发生变动的风险。债券是一种法定的契约，大多数债券的票面利率是固定不变的（浮动利率债券与保值债券例外），当市场利率上升时，债券价格下跌，使债券持有者的资本遭受损失。因此，投资者购买的债券离到期日越长，则利率变动的可能性越大，其利率风险也相对越大。

2) 收回风险：一些债券在发行时规定了发行者可提前收回债券的条款，这就有可能发生债券在一个不利于债权人的时刻被债务人收回的风险。当市场利率一旦低于债券利率时，收回债券对发行公司有利，这种状况使债券持有人面临着不对称风险，即在债券价格下降时承担了利率升高的所有负担，但在利率降低，债券价格升高时却没能收到价格升高的好处。

3) 突发事件风险：这是由于突发事件使发行债券的机构还本付息的能力发生了重大的事先没有料到的风险。这些突发事件包括突发的自然灾害和意外的事故等，例如，一场重大的事故会极大地损害有关公司还本付息的能力。

4) 税收风险：表现为两种形式：一是投资免税的政府债券的投资者面临着权入税率下调的风险，税率越高，免税的价值就越大，如果税率下调，免税的实际价值就会相应减少，债券的价格就会下降；二是投资于免税债券的投资者面临着所购买的债券被有关税收征管当局取消免税优惠的风险。

5) 政策风险：是指由于政策变化导致债券价格发生波动而产生的风险。

（8）投资永续债的特定风险

1) 发行人行使续期选择权的风险：永续债没有固定到期日，发行条款约定发行人可在特定时点有权延长本期债券，如果发行人可在可行使续期选择权时行权，会使投

资人投资期限变长，由此可能给投资人带来一定的投资风险。

2) 利息递延支付的风险：根据永续债条款约定，发行人有权递延支付利息，如果发行人决定利息递延支付，则会使投资人获取利息的时间推迟，甚至中短期内无法获取利息，由此可能给投资人带来一定的投资风险。

3) 发行人行使赎回选择权的风险：据永续债条款约定，首个重定价周期末及以后每个付息日，以及因政策变动及其他因素导致本期债券无法分类为权益工具，发行人均有权提前赎回本期债券。如果发行人决定行使赎回选择权，则可能给投资人带来一定的赎回投资风险。

(9) 可转换债券的投资风险

本资产管理计划投资于可转换公司债券（包含可分离交易可转债），无法完全规避发债主体特别是可转债、企业债和公司债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险；另外可转债的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，忽视这些条款导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转债的价格明显高于其赎回价格时，若本资产管理计划未能在转债被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

(10) 投资可交换债券的风险

1) 可交换债券的收益波动风险：可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括：①持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；②当标的股票二级市场价格高于换股价时，通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价；③在报价系统公司以高于票面价值转让的收益等。

2) 股票质押担保风险：可交换债券可能采用股票质押担保方式，预备用于交换的股票及其孳息（包括送股、转股和现金红利）一并予以质押给受托管理人，用于对债券持有人交换股份和本期私募债券本息偿付提供担保；若标的股票价格大幅下跌，且发行人不对换股价格进行修正时，将影响到质押股票对债券本息偿付的最终保障效果。

3) 换股风险：主要包括：①换股期内标的股票价格可能低于换股价格而影响投

资收益的风险；②债券的赎回条款可能导致债券提前兑付或换股期缩短而影响投资收益的风险；③换股价格向下修正条款触发时，董事会未同意修正换股价格的风险；④预备可交换的股票被限售、冻结，或因标的股票重大事项导致暂停换股时间超过债券存续期等导致投资者无法换股的风险。

4) 发行人资信风险：若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，将可能使发行人资信状况恶化，发行人上述受限资产将可能用于对相关债权人的偿付，发行人的资产将会大幅减少，并面临集中偿付的巨大压力，届时发行人的偿债能力将严重下降，从而影响债券还本付息。

(11) 所投资资产管理产品的特别风险

1) 本计划投资于各类资产管理产品的，管理人对发行资产管理产品公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资资产管理产品的投资经理的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、投资经理判断有误、投资经理的行为违反法律法规的规定、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响资产管理产品的收益水平，从而产生风险。

2) 本计划所投资的资产管理产品可能因为收取业绩报酬，导致计划份额净值及累计份额净值在资产管理产品业绩报酬提取日出现下跌，从而产生风险。

3) 本计划投资于固定收益类资产管理产品。

固定收益类产品主要投资于存款、债券等债权类资产，面临信用风险、市场风险、政策风险、经济周期风险等各类风险，因而最终对本计划造成风险。

(十) 税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

(十一) 巨额赎回情形下的风险

本集合计划触发巨额赎回条款约定的情形时，管理人经与托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及集合资产管理计划合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下管理人流动性风险管理的辅助措施。当集合资产管理计划管理人认为支付投资人

的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合资产管理计划资产净值造成较大波动时，可综合运用包括延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项等流动性风险管理工具，投资者将面临其赎回申请被拒绝或延期办理、赎回款项延缓支付、承担更高的投资成本等的风险。

（十二）销售机构涉及的特别风险提示

本计划可由销售机构进行销售，销售机构负责履行适当性管理义务并承担不适当销售行为所产生的责任。鉴于管理人与销售机构并非同一法律实体，管理人无法保证销售机构（及其销售人员，其余同）持续满足销售资格或相关监管规定及内部控制要求，无法保证销售机构按照相关法律法规及规章、自律规则等规定进行销售或募集活动，若因销售机构不符合资质、规定或内部控制要求、未按照相关法律法规及规章、自律规则等规定进行销售或募集活动，可能给投资者带来风险。

为切实维护投资者合法权益，管理人特此提示投资者审慎注意并防范如下违规或不当销售行为及其可能产生的风险，包括但不限于：

（1）销售机构或销售机构工作人员不具备法律法规、规章或自律规则所要求的相应资质，或者内部控制、销售管控流程不合规；

（2）销售机构使用非正式或非管理人认可的，与本计划资产管理合同、风险揭示书、计划说明书内容不符或相冲突的销售文件或材料；为免歧义，管理人提示：本计划法律文件及推介材料仅包含【资产管理合同、风险揭示书、计划说明书、推广公告】，除此之外的其他材料均不构成本计划的推介材料，亦不作为管理人的任何要约、承诺或同等性质意思表示；

（3）销售机构以公开方式销售推介本产品，或采取夸大收益、隐瞒风险或者预测收益等方式误导投资者；

（4）销售机构未能综合理性人能够理解的客观标准和投资者能够理解的主观标准真实、准确、完整地介绍本计划投资运作安排等情况；

（5）销售机构违规宣称产品保本保收益，引诱投资者投资；

（6）销售机构未能建立金融产品风险评估制度，未将产品特性、产品风险对客户进行充分告知；

（7）销售机构未能对投资者风险认知、风险偏好、风险承受能力、投资目标进行准确评估测试；

(8) 销售机构未经了解投资者风险承受能力、投资期限、品种、期望收益、投资目标等情况、未进行投资者风险承受能力评测而先行向投资者推介；

(9) 销售机构对投资者的风险承受能力评估标准不客观，未结合投资者的年龄、职业、教育经历、投资经验等特性进行深入评估；

(10) 销售机构误导投资者签署包括空白风险承受能力评测问卷等在内的销售材料或产品法律文件；或投资者未自行签署该等材料或文件；

(11) 销售机构向不符合准入要求的投资者销售产品或者提供服务；

(12) 销售机构向投资者就不确定事项提供确定性的判断，或者告知投资者有可能使其误认为具有确定性的意见；

(13) 销售机构向投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或者服务；

(14) 销售机构向投资者主动推介不符合其投资目标的产品或者服务；

(15) 销售机构未能以合理客观的标准并结合投资者年龄、职业、教育经历或投资经验等特定主观因素，将产品风险收益特征和投资运作安排详尽、完整地介绍给投资者；

(16) 在法律法规及规章有规定要开展相应录音录像工作的情况下，销售机构未能按照法律法规、规章要求对销售行为开展录音或录像；

(17) 其他不符合法律法规等规定的销售行为。

(十三) 其他风险

包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

对于上述违规或不当销售行为，管理人提示投资者不应采信。投资者应在排除上述干扰的情形下，客观合理审视本计划风险收益特征与投资运作安排，结合本人实际情况独立做出认购或不认购本产品的决策。如遇违规、不当销售行为，投资者可立即向其提出或联系管理人，管理人不对销售机构违规、不当销售行为承担责任，并有权要求相关机构改正。

管理人应当单独编制风险揭示书作为合同附件。投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，并做出自愿承担风险的陈述和声明。

第二十四部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算

一、资产管理合同的变更

1、各方书面一致同意，以下事项可由管理人自行决定变更：

- (1) 调低管理人的报酬标准；
- (2) 调低参与费、退出费的费率；
- (3) 投资经理的变更；
- (4) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

2、各方书面一致同意，以下事项可由管理人和托管人协商后变更：

- (1) 调低托管人的报酬标准；
- (2) 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效；

- (3) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、除前文第1项、第2项所述之外的其余事项如需发生变更的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。

特别约定：在本集合计划投资者人数少于3名（含3名）的情况下，经全体投资者、管理人、托管人同意，也可通过签署补充协议的方式进行合同变更，采用该等方式变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者和托管人同意，并履行合同变更程序。

4. 全体投资者、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后，也可对本合同内容进行变更，但资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。

5. 合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

6. 投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

二、本合同发生变更的，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案。

三、管理人和托管人的更换

（一）管理人或托管人变更的情形

管理人变更的情形：管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。

托管人变更的情形：托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接；

（二）管理人或托管人变更程序

（1）发生管理人、托管人变更的情形的，需在发生之日起6个月内完成变更程序，否则本集合计划终止；

（2）管理人或托管人变更需经过投资者同意。管理人应当通过管理人网站公告或邮件通知等方式向投资者通知变更征询意见；投资者需在征询意见发出之日起5个工作日内向管理人做出是否同意回复。投资者不同意变更的，应在征询意见发出之日起5个工作日内向管理人提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回

复意见或意思表示不明确或未在征询意见发出之日起5个工作日内提出退出计划申请的，视为投资者同意管理人或托管人变更，不再接受投资者退出申请；

(3) 管理人变更公告，应当在管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让生效后由新管理人通过指定的网站或邮件通知等方式向投资者公告；托管人变更公告，应当在托管人变更后，由新托管人通过网站公告方式告知投资者；

(4) 管理人变更/托管人变更公告生效后，管理人应当与托管人重新签署资产管理合同，并将签署后的资产管理合同进行披露。

(5) 对于不同意管理人或托管人变更的投资者，管理人应当在公告生效后5个工作日内设置特别开放期，为不同意变更的投资者办理强制退出；

(6) 完成管理人或托管人变更工作后，管理人、托管人及变更后管理人、变更后托管人应当根据相关规定进行报备或报告（如需）。

(三) 新管理人接收计划管理业务或新托管人接收计划财产和计划托管业务前，原管理人或原托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对投资者的利益造成损害的行为。

四、资产管理计划的展期

(一) 资产管理计划展期应符合以下条件：

1. 本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2. 本计划展期没有损害投资者利益的情形；

3. 中国证监会规定的其他条件；

(二) 本计划展期的，应当符合本计划的成立条件。

(三) 展期的程序与期限

1. 展期的公告

集合计划符合展期条件拟展期且管理人和托管人达成一致，管理人在管理人网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。

2. 投资者答复

投资者应根据管理人指定网站上公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者明确回复同意本集合计划展期或未回复意见的，视为同意展期；投资者明确回复不同意本集合计划展期的，视为不同意展期。

3. 投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期，投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理本计划份额退出、转让手续，则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理转让或退出手续，视为不同意展期，管理人不再另行通知确认。

4. 展期的实现

如果同意计划展期的投资者人数不少于2人，则本计划存续期将依法展期；如果同意计划展期的各投资者人数低于2人，则本计划到期终止，管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。

5. 展期情况备案

本集合计划展期后5个工作日内，管理人将展期情况公告并按照法律法规要求报相关监管机构或自律组织等备案（如需）。

五、资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：

（一）资产管理计划存续期届满且不展期；

（二）经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；

（三）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；

（四）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；

（五）持续五个工作日投资者少于2人的；

（六）未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；

（七）因本集合计划规模等原因导致无法有效地进行投资，或者管理人认为本计划的投资策略已不适当当时的市场环境时，管理人可以与托管人协商一致提前终止本计划，并至少提前1个工作日以公司网站公告等方式告知投资者；

（八）法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

发生管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产情形时，托管人有权立即对托管账户采取止付措施。

管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，前述第（七）项约定的情形除外。

六、资产管理计划的清算

管理人应在本计划发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算。

（一）资产管理计划财产清算小组

1. 资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

2. 资产管理计划财产清算小组负责计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（二）资产管理计划财产清算的程序

1. 本合同终止时，由资产管理计划财产清算小组统一接管财产；
2. 对本计划财产进行清理和确认；
3. 对本计划财产进行估价和变现；
4. 制作清算报告；
5. 对本计划剩余财产进行分配。

（三）清算费用的来源和支付方式

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划财产清算过程中发生的所有合理费用、清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从计划财产中支付。

（四）资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

1. 资产管理计划财产按如下顺序进行清偿：

- (1) 支付资产管理计划财产清算费用；
- (2) 缴纳资产管理计划所欠税款；
- (3) 清偿资产管理计划债务；

(4) 清算后如有余额，按资产管理计划份额持有人持有的资产管理计划份额比例进行分配并分别扣除应计提业绩报酬(如有)。2. 依据资产管理计划财产清算的分配方案，将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划投资者持有的计划份额比例以现金形式进行分配，本合同另有约定的除外。

3. 因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的，管理人应将已变现部分先行分配，并于本计划终止后对计划财产进行二次清算。清

算期间继续根据本合同约定提取管理费、托管费等相关费用及业绩报酬（如本合同已明确约定业绩报酬的收取）。待上述资产可以变现时，管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行二次清算，并在扣除相关费用和业绩报酬（如有）后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有多只流通受限的证券及其他投资产品的，管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令，托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。

4. 在计划财产移交前，由托管人负责保管。清算期间，任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产，发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因投资者原因导致计划财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

（五）本计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

（六）资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算小组在本计划终止后30个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案。

（七）资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销本计划托管账户及本计划投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

（八）资产管理计划财产清算账册及文件的保存

本计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上。

第二十五部分 违约责任

一、本合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中，因违反法律法规或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损害的，应按过错原则分别对各

自的行为承担赔偿责任。

发生下列情况的，当事人可以免责：

（一）不可抗力；

（二）管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

（三）管理人由于按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

（四）资产管理计划管理人、资产管理计划托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、中国期货市场监控中心等）发送或提供的数据错误给本集合计划资产造成的损失等；（五）管理人与销售机构（如有）为不同法律实体，管理人不对销售机构因违法违规或不当销售行为而引起的损失承担责任。

（六）管理人不承担因投资者向管理人或销售机构提供虚假信息或证明材料而因此销售产品或提供服务的不利后果及责任。

（七）投资者因拒绝听取管理人或销售机构的建议等而认购或接受不适当产品、服务的，管理人不承担由此产生的责任及损失。

（八）因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为；

三、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

四、因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，投资者应先于其他受损方获得赔偿。

五、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或投资者损失，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

六、本合同一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

七、托管人因违反法律法规或资产管理合同，给计划资产造成损失的，应承担赔偿责任。管理人及其他第三方机构因发生违法违规行为给计划资产造成损害的，应当由各机构自行承担责任。

第二十六部分 争议的处理

一、对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，采取以下第（一）种方式解决：

（一）向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，仲裁地点在上海，以该会当时有效的仲裁规则为准，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担；

（二）向本合同签署地（上海徐汇区宛平南路8号）所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

二、争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

三、本合同受中华人民共和国法律管辖。

第二十七部分 资产管理合同的效力

一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立（如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件）。投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。本合同自

本计划成立之日起生效。

二、本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

三、本合同的有效期限为自成立之日起【十】年。

四、投资者自签订本合同即成为本合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出计划之日起不再是本合同的当事人。

第二十八部分 其他事项

一、本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的（法律法规或司法监管部门要求的除外）。本保密义务不因合同终止而终止。

二、如将来监管部门对本合同的内容与格式有其他要求的，投资者、管理人和托管人应立即展开协商，根据监管相关要求修改本合同的内容和格式。

三、除本合同另有约定外，任何与本合同有关的通知、报告应以书面形式作出，由本合同一方以专人递送给其他当事人，或以传真、邮递方式发出。该等通知以专人递送，于递交时视为送达；以传真方式发出，于收件人传真机显示收到时视为送达；以邮递方式发出，收件人签收之日视为送达。

四、管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务。

五、本合同一式【叁】份，当事人各执壹份，报基金业协会备案【壹】份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

本页无正文，为《【华鑫证券鑫享添利2号】集合资产管理计划资产管理合同》
签署页

投资者：（章）

法定代表人或授权人：

签署日期： 年 月 日

资产管理人：（章）

法定代表人或授权人：



签署日期：2022年9月23日

资产托管人：上海银行股份有限公司（章）

法定代表人或授权人：合同专用章



签署日期：2022年9月26日

附件一：专用清算账户及资金划拨专用账户

专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

托管账户

户名：华鑫证券鑫享添利2号集合资产管理计划

账号：03005079909

开户银行：上海银行市南分行

管理费收款账户

户名：华鑫证券有限责任公司

账号：0764152322000913

开户银行：上海浦发银行徐汇支行

大额支付号：310290000177

增值税以及交易费用收款账户

户名：华鑫证券有限责任公司

账号：0764152322000913

开户银行：上海浦发银行徐汇支行

大额支付号：310290000177

托管费收款账户

账户名：资产托管费

开户行：上海银行市南分行

账号：PL52613

附件二：管理人关联方名单

华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表		
持有本公司 5%以上股份的股东情况		
序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/ 注册号（境外机构）/身份证号（个人）/ 护照号（外籍个人）
1	上海华鑫股份有限公司	9131000013220382XX
本公司的控股股东情况		
1	上海华鑫股份有限公司	9131000013220382XX
本公司的控股股东控制的其他子公司情况		
序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/ 注册号（境外机构）
1	上海金欣联合发展有限公司	91310101132352737T
2	上海金陵投资有限公司	91310115132310625R
3	上海择励实业有限公司	91310230057678883Q
4	上海普林电路板有限公司	310104000015714
5	上海普林电子有限公司	310000400435444
6	上海鑫敦实业有限公司	9131023008009785XR
7	上海力敦行房地产经纪有限公司	91310115787820407L
8	华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司	91310000MA1FL02T7J
9	上海鑫之众投资管理有限公司	91310000MA1FL3EG5U
10	上海全创信息科技有限公司	91310104MA1FRJB1XP
11	烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司	91370602MA3QWYREXU
12	天津东疆基金管理有限公司	91120118MA06EA4NX9
本公司的控股子公司及本公司能够实施重大影响的其他公司情况		
序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/ 注册号（境外机构）
1	华鑫期货有限公司	91310000132110746J
2	华鑫证券投资有限公司	913100000841449245
3	华鑫宽众投资有限公司	91310000351133569C
4	摩根士丹利证券（中国）有限公司	913100007178847982
5	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	91440300746637454W

附件三 托管人关联方名单

更新日期：2022年6月30日

托管人：上海银行股份有限公司

序号	关联方名称
1	上海联和投资有限公司
2	上海国际港务(集团)股份有限公司
3	西班牙桑坦德银行有限公司 (BANCO SANTANDER, S. A.)
4	TCL 科技集团股份有限公司
5	中国建银投资有限责任公司
6	中船国际贸易有限公司
7	上海商业银行有限公司
8	上海企顺建创资产经营有限公司 (原上海市黄浦区国有资产总公司)
9	上海卢湾财政投资有限公司 (原上海卢湾财政投资公司)
10	上海银行(香港)有限公司
11	上银国际有限公司
12	上银基金管理有限公司
13	上海闵行上银村镇银行股份有限公司
14	浙江衢州衢江上银村镇银行股份有限公司
15	江苏江宁上银村镇银行股份有限公司
16	崇州上银村镇银行股份有限公司
17	上海尚诚消费金融股份有限公司
18	上银理财有限责任公司

注：1、上述名单为截止 2022 年 6 月 30 日的我行关联方名单，如后续我行更新关联方名单后，以后续更新的关联方清单为准；

2、本名单仅用于根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十三条、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第二十六条审查关联交易使用。

附件四：预留印鉴授权书

华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、上海银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为【HXZQ-XXTL-202209-2】的《华鑫证券鑫享添利2号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。

管理人预留印鉴
<p>(用章样本)</p> 

上述预留印鉴如需更换，应提供加盖管理人公章的新的预留印鉴样本。新的预留印鉴样本相应替代原有预留印鉴样本。未提供加盖公章的新预留印鉴样本的，预留印鉴不得更换。

管理人：华鑫证券有限责任公司（公章）



2021年9月23日

附件五：资产管理人指定发送邮箱

资产管理人向资产托管人发送投资指令的指定邮箱如下：

- 1、qiuwq@cfsc.com.cn
- 2、gaoxy@cfsc.com.cn
- 3、luowj@cfsc.com.cn
- 4、zangxy@cfsc.com.cn
- 5、lilt@cfsc.com.cn
- 6、liqx@cfsc.com.cn
- 7、zhaoqian@cfsc.com.cn

以上指定邮箱作为资产托管人识别资产管理人的依据之一，若资产管理人非由指定邮箱向托管人发送的投资指令，托管人有权拒绝执行，责任由过错方承担。若资产管理人变更指定邮箱，由资产管理人向资产托管人发送加盖资产管理人公章或预留印鉴的指定邮箱变更通知扫描件，指定邮箱的变更自资产托管人收到指定邮箱变更通知的扫描件之日起生效。



附件六：华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书

尊敬的投资者：

华鑫证券鑫享添利 2 号集合资产管理计划投资者通过【管理人直销渠道】认购或申购本集合资产管理计划的，基金投资者应当将认购款或申购款以其境内开立的银行账户划款至【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户。本集合资产管理计划【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由管理人委托运营服务机构开立，该账户仅用于华鑫证券鑫享添利 2 号集合资产管理计划募集期间和存续期间【管理人直销渠道】认购、申购和赎回资金的统一归集与支付。

【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户信息如下：

账户名：华鑫证券有限责任公司

账号：

开户行：广发银行上海徐汇支行

大额支付号：306290003526

自华鑫证券鑫享添利 2 号集合资产管理计划推广募集之日起，本集合资产管理计划【管理人直销渠道】投资人认购、申购和赎回资金的归集与支付均通过上述募集结算资金归集专用账户进行。特此告知！

华鑫证券有限责任公司（预留印鉴）

日期： 年 月 日